

# 宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金更新招募说明书摘要

**基金管理人:宝盈基金管理有限公司**  
**基金托管人:中国工商银行股份有限公司**  
**日期:二〇一一年三月**

**重要提示**

基金管理人承诺恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉地管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者投资于本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。基金管理人的过往业绩并不代表将来业绩。

投资有风险,投资者购买基金时应认真阅读招募说明书。

本摘要根据本基金的基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金管理人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务;基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅本基金的基金合同。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准,但中国证监会对本基金核准,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金会有风险。

本本基金基金合同自2005年3月8日起正式生效。本招募说明书(更新)所载内容截止日为2011年3月8日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年12月31日。基金托管人中国工商银行对本招募说明书(更新)中的投资组合报告和业绩表现进行了复核确认。

**一、基金管理人**

(一)基金管理人概况

1.基金管理人基本情况  
名称:宝盈基金管理有限公司  
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦1501  
成立时间:2001年5月18日  
法定代表人:李建生  
总经理:汪钦

办公地址:深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层  
注册资本:10000万元人民币  
电话:0755-83276688  
传真:0755-83515599  
联系人:葛俊杰

2.基金管理人股权结构及组织结构  
本基金管理人是经中国证监会证监基金字[2001]9号文批准发起设立,现有股东包括中铁信托有限责任公司、成都工业投资集团有限公司、中国对外经济贸易信托有限公司。其中中铁信托有限责任公司持有本公司49%的股权,成都工业投资集团有限公司持有26%的股权,中国对外经济贸易信托有限公司持有25%的股权。

公司下设投资部、海外交易部、特定客户资产管理部、研究部、金融工程部、集中交易室、市场部、华北营销中心、华东营销中心、华南营销中心、电子商务部、基金运营部、监察稽核部、公司财务部、总经理办公室等15个部室和北京办事处、上海办事处;此外,还设立了投资决策委员会、风险控制委员会和信息技术治理委员会。

公司以“规范管理求效益、诚信创新谋发展、回报服务创品牌”为经营理念,坚持“诚实信用、勤勉尽责”的企业精神,立足专业,追求卓越,致力于开拓基金及证券市场业务,为基金份额持有人和资产委托人谋取更大利益。

(二)主要人员情况  
1、公司高级管理人员  
① 董事会:  
李建生女士,董事长,1954年生,中共党员,本科。曾在黑龙江建设银行、铁道部基建总局工作。1989年始历任中国铁路工程总公司副处、高级会计师、副总会计师,现任中铁信托有限责任公司董事长,中国中铁股份有限公司副总裁、财务总监兼法律顾问。

景开强先生,董事,1958年生,硕士研究生,高级会计师。1985年7月至1989年10月在中铁二局机筑公司广州、深圳、珠海项目部任职,历任助理会计师、会计师、财务主管;1989年11月至2001年4月在中铁二局机筑公司财务科任职,历任副科长、科长、总会计师;2001年5月至2003年10月在中铁二局股份公司任财会部部长,中铁二局集团专家委员会财务组组长;2003年11月至2005年10月在中铁八局集团公司任总会计师、总法律顾问,集团公司专家委员会成员;现任中铁信托有限责任公司总经理。

陈赤生先生,董事,1966年生,中共党员,经济学博士。1988年7月至1998年5月任西南财经大学公共与行政管理学院教授、1998年5月至1999年3月在四川省信托投资公司人事部主任任职;1999年3月至2000年10月在四川省信托投资公司峨眉山办事处任总经理助理,2000年10月至2003年6月在和兴证券有限责任公司工作;2003年6月开始任衡平信托投资有限公司任总裁助理兼研究发展部总经理,现任中铁信托有限责任公司副总经理兼董事兼秘书。

张一冰女士,董事,1967年生,中共党员,陕西财经学院硕士。1989年7月起,在中国华大理工技术公司任财务主任;1990年5月至1999年5月,在中国对外经济贸易信托投资公司任计财部、综合部和证券部主任;1999年6月,在香港第一大平银银行任投资银行部副经理;2001年4月起,在中国对外经济贸易信托投资公司先后担任投资银行部、稽核法律部总经理,现任中国对外经济贸易信托有限公司投资发展部总经理。

曾康霖先生,独立董事,1938年生,中共党员,西南财经大学教授。1951年至1956年,在四川省泸县税务局工作;1956年至1960年,在西南财经大学学习;1960年至今,在西南财经大学任教,现任西南财经大学中国金融研究中心名誉主任,博士生导师。

贺顺奇先生,独立董事,1962年生,中共党员,管理学博士。1986年至1992年,在河北大学经济系任教;1995年至2001年,在厦门大学管理学院任教;2001年至2003年在清华大学经济管理学院管理学博士后流动站从事博士后研究工作;2003年7月至2010年4月,在清华大学会计研究所从事教学与科研工作,任清华大学会计研究所党支部书记、副教授;2010年5月至今,在北京国家会计学院任副教授。

屈文洲先生,独立董事,1972年生,中共党员,金融学博士。1995至1997年,任厦门建发信托投资公司海滨证券营业部投资信息部主任;1997至2001年,任厦门建发信托投资公司投资银行部经理;1998至1999年,任调中国证监会厦门特派办上市公司监管处;2001年至2003年任厦门博实投资咨询有限公司总经理;2003至2005年任深圳证券交易所研究部;2005至今,在厦门大学管理学院从事教学与研究工作,现任厦门大学管理学院教授、博士生导师,厦门大学中国资本市场监管中心主任,厦门大学管理学院财务系副主任。兼任厦门空港、山东航空、梅花伞、众和股份独立董事。

汪钦先生,1966年生,中共党员,经济学博士。曾就职于中国人民银行河南省分行教育处、海南港澳国际信托投资公司证券部,历任三业东方实业股份有限公司副总经理、国信证券股份有限公司研究所所长、长城基金管理有限公司副总经理。2010年11月起任宝盈基金管理有限公司总经理。

**0 监事会**  
王连洲先生,独立监事,1939年生,副研究员。1964年至1983年,在中国人民银行印制局工作,曾担任计划处副处长;1983年至2000年,在全国人大财经委员会工作,主要从事金融立法,先后担任办公室财金组副组长、组长、办公室副主任、研究室巡视员。2000年11月退休。

杨凯先生,员工监事,1974年生,中山大学岭南学院MBA。2003年7月至今,在宝盈基金管理有限公司工作,先后担任市场部总监助理,市场部总监、特定客户资产管理部总监。目前,其担任宝盈基金管理有限公司总经理助理兼研究部总监。

张建华女士,监事,1969年生,高级经济师。曾就职于四川新华印刷厂、成都科力风险投资公司、成都工商信托有限公司、衡平信托有限责任公司。现任中铁信托有限公司理财中心总经理。

**6 其他高级管理人员**  
孙胜华先生,1971年生,中共党员,法学硕士。曾在中信信托总公司、中国信达资产管理公司、英国 Wyvern (China) 投资银行、中国泛海控股集团、民生证券有限责任公司、华夏基金管理有限公司从事法律工作。2010年3月加入宝盈基金管理有限公司任总经理助理兼监察稽核部总监,2010年11月起任宝盈基金管理有限公司督察长。

**2.基金经理简历**  
高峰先生,1971年10月生,北京大学经济学硕士。1995年8月-2000年7月任中国化工进出口总公司财务部财务综合部经理,中国对外经济贸易信托投资有限公司计划财务部财务科科长和公司发展战略小组成员。2000年8月-2003年8月加入宝盈基金管理有限公司,参加公司的筹备工作。2003年5月公司正式成立后,历任研究发展部高级分析师、副总经理。2003年9月-2009年10月,任证券业务部总经理,资产管理部执行总经理,高级投资经理,公司投资决策委员会成员,任富锦证券投资基金基金经理,证券投资管理人。2009年10月加入宝盈基金管理有限公司,现任总经理助理兼投资部总监,宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理。

宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金历任基金经理姓名及管理本基金时间:  
夏和平,2009年12月26日至2010年11月19日。  
陆万山,2009年3月3日至2010年9月2日。  
姚刚,2007年5月9日至2009年5月12日。  
祝东升,2005年3月8日至2007年5月9日。

3.本公司投资决策委员会成员的姓名和职务如下:  
汪钦先生,宝盈基金管理有限公司总经理。  
高峰先生,宝盈基金管理有限公司总经理助理兼投资部总监、海内证券投资部基金经理、宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金基金经理。  
杨凯先生,宝盈基金管理有限公司总经理助理兼研究部总监。  
余述胜先生,宝盈策略增长股票型证券投资基金基金经理。  
陈若劲女士,宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、宝盈货币市场证券投资基金基金经理。

**二、基金托管人**

(一)基金托管人基本情况  
基金托管人名称:中国工商银行股份有限公司  
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号  
法定代表人:姜建清  
成立时间:1984年1月1日  
批准设立机关及批准设立文号:国务院《关于中国人民银行实行“三行一总局”体制的决定》(国发[1983]146号)

组织形式:股份有限公司  
注册资本:人民币334,018,880,026元  
存续期间:持续经营  
经营范围:  
办理人民币存款、贷款、同业拆借业务;国内外汇兑;办理票据承兑、贴现、转贴现、各类汇兑业务;代理资金清算;提供信用证服务及担保;代理销售业务;代理发行、代理承销、代理兑付政府债券;代收代付业务;代理证券投资基金清算业务(银证转账);保险代理业务;代理政策性银行、外国政府和国际金融机构贷款业务;保管箱服务;发行金融债券;买卖政府债券、金融债券;证券投资基金、企业年金托管业务;企业年金受托管理服务;年金账户管理服务;开放式基金的注册登记、认购、申购和赎回业务;资信调查、咨询、见证业务;贷款承诺;企业、个人财务顾问服务;组织或参加银团贷款;外汇存款;外汇贷款;外汇兑换;出口托收及进口代收;外汇票据承兑和贴现;外汇借款;外汇担保;发行、代理发行、买卖或代理买卖股票以外的外币有价证券;自营、代客外汇买卖;外汇金融衍生业务;银行卡业务;电话银行、网上银行、手机银行业务;办理结汇、售汇业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务。

(二)主要人员情况  
截至2010年12月末,中国工商银行资产托管部共有员工133人,平均年龄30岁,95%以上员工拥有大学本科以上学历,高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。  
(三)基金托管业务经营情况  
作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国工商银行自1998年在国家首开托管服务以来,秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨,依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理流程、先进的营运系统和专业的服务团队,严格履行资产托管人职责,为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务,展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最早、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、安心账户资金、企业年金基金、QDII资产、QDII资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII专户资产、ESCROW等门类齐全的托管产品体系,同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务,可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至2010年12月,中国工商银行共托管证券投资基金198只,其中封闭式8只,开放式190只。自2003年以来,本行连续七年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的23项最佳托管银行大奖;2010年,本行资产托管部总经理获得《财资》设立的年度中国最佳托管银行个人大奖。本行是获得奖项最多的国内托管银行,优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

**三、相关服务机构**

(一)基金份额发售机构  
1.直销机构:宝盈基金管理有限公司  
住所:深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层  
法定代表人:李建生  
电话:0755-83276688  
传真:0755-83515880  
联系人:方仲健  
2.代销机构:  
(1)中国工商银行  
注册地址:北京市西城区复兴门内大街55号  
客户服务热线:95588  
公司网址:www.icbc.com.cn  
(2)中国建设银行  
注册地址:北京市西城区金融大街25号  
客户服务热线:95533  
公司网址:www.ccb.com  
(3)中国银行  
注册地址:北京市西城区复兴门内大街1号  
客户服务热线:95566  
公司网址:www.boc.cn  
(4)交通银行  
注册地址:上海市仙霞路18号  
客户服务热线:95559  
公司网址:www.bankcomm.com  
(5)招商银行  
注册地址:深圳市福田区深南大道7088号  
客户服务热线:95555  
公司网址:www.cmbchina.com  
(6)中信银行  
注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座  
客户服务热线:95558  
公司网址:www.citic.com  
(7)中国民生银行  
注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号  
客户服务热线:95568  
公司网址:http://www.cmbc.com.cn/  
(8)北京银行  
注册地址:北京市西城区金融大街甲17号首层  
客户服务热线:95526  
公司网址:http://www.bankofbeijing.com.cn  
(9)平安银行  
注册地址:深圳市深南中路1099号平安银行大厦  
客户服务热线:40066-99999  
公司网址:http://www.18ebank.com/  
(10)国泰君安证券  
注册地址:上海市浦东新区商城路618号  
客户服务热线:4008888666  
公司网址:www.gja.com  
(11)中信建投证券  
注册地址:北京市新中街68号  
客户服务热线:4008888108  
公司网址:www.csc108.com  
(12)国信证券  
注册地址:深圳市红岭中路1012号国信证券大厦  
客户服务热线:95536  
公司网址:www.guosen.com.cn  
(13)招商证券  
注册地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座39-45层  
客户服务热线:95565  
公司网址:www.newone.com.cn  
(14)广发证券  
注册地址:广州市天河区北路183号大都会广场45楼  
客户服务热线:020-87558888-875  
公司网址:www.gf.com.cn  
(15)中信证券  
注册地址:深圳市湖贝路1030号海龙王大厦  
客户服务热线:95558  
公司网址:www.cs.citic.com  
(16)中国银河证券  
注册地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦A座  
客户服务热线:4008888888  
公司网址:www.chinastock.com.cn  
(17)海通证券  
注册地址:上海市淮海中路98号  
客户服务热线:4008888001  
公司网址:www.htsec.com  
(18)华泰联合证券  
注册地址:深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层 01A、02、03、04、17A、18A、24A、25A、26A  
客户服务热线:95513  
公司网址:www.lhczq.com  
(19)申银万国证券  
注册地址:上海市常熟路171号  
客户服务热线:021-962505  
公司网址:www.syrw.com.cn  
(20)兴业证券  
注册地址:福建省福州市湖东路99号力大厦  
客户服务热线:021-68419974  
公司网址:www.xyzq.com.cn  
(21)长江证券  
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦  
客户服务热线:4008888999  
公司网址:www.cjsc.com.cn

(22)安信证券  
注册地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元  
客户服务热线:0755-82825555  
公司网址:www.essences.com.cn  
(23)西南证券  
注册地址:重庆市渝中区临江路2号合景国际大厦22-25层  
客户服务热线:023-63786187  
公司网址:www.swsc.com.cn  
(24)中信金通证券  
注册地址:浙江省杭州市中河南路11号万凯庭商务楼A座  
客户服务热线:0571-96598  
公司网址:www.bigsun.com.cn  
(25)万联证券  
注册地址:广州市中山二路18号电信广场36-37层  
客户服务热线:4008888133  
公司网址:www.wlqz.com.cn  
(26)国元证券  
注册地址:安徽省合肥市寿春路179号  
客户服务热线:4008887777  
公司网址:www.gyzq.com.cn  
(27)渤海证券  
注册地址:天津市河西区滨水道3号  
客户服务热线:022-28455888  
公司网址:www.cwww.com.cn  
(28)华泰证券  
注册地址:江苏省南京市中山东路90号  
客户服务热线:025-84457777  
公司网址:http://www.htsc.com.cn  
(29)中信万通证券  
注册地址:青岛市崂山区香港东路316号  
客户服务热线:96577  
公司网址:www.zxwt.com.cn  
(30)东吴证券  
注册地址:江苏省苏州工业园区翠园路181号商旅大厦  
客户服务热线:0512-96288  
公司网址:www.dwzq.com.cn  
(31)东方证券  
注册地址:上海市中山南路318号2号楼  
客户服务热线:021-962506  
公司网址:www.dfzq.com.cn  
(32)长城证券  
注册地址:深圳市深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层  
客户服务热线:0755-82288968  
公司网址:www.cc168.com.cn  
(33)国联证券  
注册地址:江苏省无锡市县前东街168号国联大厦6层  
客户服务热线:0510-82588168  
公司网址:www.glsc.com.cn  
(34)浙商证券  
注册地址:浙江省杭州市杭大路1号  
客户服务热线:95105665  
公司网址:www.stocke.com  
(35)平安证券  
注册地址:深圳市福田区八卦三路平安大厦  
客户服务热线:95511  
公司网址:www.pzmb.com  
(36)国海证券  
注册地址:广西壮族自区南宁市滨湖路46号  
客户服务热线:0771-55339032  
公司网址:www.gzhq.com.cn  
(37)国都证券  
注册地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层 010007  
客户服务热线:400-818-8118  
公司网址:www.guodu.com  
(38)东海证券  
注册地址:上海市浦东新区东方路989号中达广场17楼  
客户服务热线:0510-8162222  
公司网址:www.longone.com.cn  
(39)湘财证券  
注册地址:江西省南昌市永叔路15号  
客户服务热线:0791-6285337  
公司网址:www.xgstock.com  
(40)华证证券  
注册地址:四川省成都市陕西街239号  
客户服务热线:4008888818  
公司网址:www.hx168.com.cn  
(41)宏源证券  
注册地址:新疆乌鲁木齐建设路2号  
客户服务热线:010-62294600  
公司网址:www.ehongyuan.com  
(42)齐鲁证券  
注册地址:山东省济南市经十路128号  
客户服务热线:0531-82084184  
公司网址:www.qzq.com.cn  
(43)第一创业证券  
注册地址:深圳市罗湖区笋岗路12号中民时代广场 B 座  
客户服务热线:0755-25832686  
公司网址:www.firstcapital.com.cn  
(44)金元证券  
注册地址:海南省海口市南宝路36号证券大厦4层  
客户服务热线:4008888228  
公司网址:www.jyzq.com.cn  
(45)中航证券  
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号  
客户服务热线:0791-6768763  
公司网址:www.scstock.com  
(46)中国建银投资证券  
注册地址:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层至20层  
客户服务热线:4006008008  
公司网址:www.cjis.cn  
(47)天源证券  
注册地址:青海省西宁市长江北路53号汇通大厦6层  
客户服务热线:0755-3333118-8806  
公司网址:www.tyzq.com.cn  
(48)厦门证券  
注册地址:厦门市莲前西路2号莲富大厦十七楼  
客户服务热线:0592-5163588  
公司网址:www.xmzq.com.cn  
(49)世纪证券  
注册地址:深圳市深南大道7088号招商银行大厦41层  
客户服务热线:0755-83199599  
公司网址:www.cscso.com.cn  
(50)中汇金公司  
注册地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层  
客户服务热线:010-85679238  
公司网址:www.cicc.com.cn  
(51)信达证券  
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层  
客户服务热线:4008008899  
公司网址:www.cindasc.com  
(52)光大证券  
注册地址:深圳市福田区华能大厦30楼  
客户服务热线:0755-26982993  
公司网址:www.evgm.com.cn  
(63)广发华福证券  
公司网址:www.hfzq.com.cn  
客户服务热线:0591-96326  
注册地址:福建省福州市鼓楼区温泉街道五四路157号  
64天相投顾  
公司网址:www.txsec.com  
客户服务热线:010-66045666  
注册地址:北京市西城区金融大街19号富凯大厦B座701  
65光大证券  
公司网址:www.ebscn.com  
客户服务热线:4008888788  
注册地址:上海市浦东新区南汇路528号上海证券大厦南塔16楼  
(二)注册登记机构  
名称:宝盈基金管理有限公司  
住所:深圳市深南大道6008号深圳特区报业大厦15层  
法定代表人:李建生  
电话:0755-83276688  
传真:0755-83275119  
联系人:陈静瑜  
(三)律师事务所和经办律师  
律师事务所名称:广东华商律师事务所  
注册地址:深圳市福田区笋岗路宝安广场A座16楼G、H  
办公地址:深圳市罗湖区笋岗路宝安广场A座16楼G、H  
法定代表人:李兆民  
经办律师:杨忠、戴瑞端  
电话:0755-82687860

传真:0755-82687861  
(四)会计师事务所和经办注册会计师  
名称:普华永道中天会计师事务所有限公司  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室  
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼  
法定代表人:杨绍信  
联系电话:021 23238888  
传真:021 23238800  
联系人:单峰  
经办注册会计师:汪峰、单峰

**四、基金名称**  
本基金名称:宝盈泛沿海区域增长股票证券投资基金。

**五、基金类别**  
本基金类型:契约型开放式股票基金。

**六、基金的投资目标**  
本基金通过投资于泛沿海地区具有增长潜力的上市公司,有效分享中国经济快速增长的成果,在严格控制基金投资风险的前提下保持基金财产持续稳健增值。

**七、基金的投资范围和对对象**  
本基金投资对象为国内依法公开上市的股票、债券、货币市场工具及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。  
本基金财产中股票资产的投资变动范围为60%-95%,债券资产投资比例变动范围为0-35%;现金或持有期限在1年以上政府债券的投资比例不低于5%。法律法规和监管部门对上述比例另有规定时从其规定。  
本基金非现金资产中,不低于80%的资金将投资于在泛沿海区域注册、上市公司的阶段性变化,以不超过非现金资产20%的部分投资于泛沿海区域以外地区注册的、具有持续增长潜力的上市公司证券。

**八、投资策略**  
本基金采取“自上而下”进行资产配置和行业及类属资产配置,自上而下”精选个股的积极投资策略。  
1.资产配置策略  
在整体资产配置层面,本基金根据宏观经济运行状况、财政、货币政策、国家产业政策及各区经济发展政策调整情况、市场环境等因素,决定股票、债券及现金的配置比例。  
2.区域资产及行业权重配置策略  
在区域资产配置及行业权重层面,本基金根据区域经济增长特点及区域内各行业经营发展情况、行业景气状况、竞争优势等因素动态调整基金资产配置在各行业的权重。  
3.个股选择策略  
在个股选择层面,本基金以PEG、每股经营活动现金流量、净利润增长率及行业地位等指标为依据,通过公司投资价值评估方法选择具备持续增长潜力的上市公司进行投资。具体选股程序为:  
(1)区域选股  
从沪深两市所有A股中选择注册地在泛沿海区域的上市公司,剔除ST、\*ST股票、亏损股票及正在接受监管部门调查的问题股票,构成本基金的泛沿海区域重点股票备选库;  
(2)数量选股  
将重点股票备选库中的所有股票,先按每股现金流量排序,选择每股现金流量较高的70%的股票,再从中选择预期PEG低于行业平均水平的股票构成股票备选库;投资股票备选库每年在4月30日上市公司年度报告发布后对整体调整一次,日常则可依据股票价格变动情况进行微调。  
预期PEG值的计算公式如下:

其中,P为计算日股票的收盘价,EPS为上市公司最新年报的每股收益;  
E为根据上市公司历史财务数据、实地调研、财务模型和其他相关信息预测的预期主营业务利润增长率。  
对于每年5月下一年度A上市的新股,本基金将其作为一个特殊资产分类,由基金管理人根据具体市场情况决定投资。

**6 基本选股**  
由基金管理人研究人对投资备选股票库中的股票进行基本面价值评估,选择预期具有持续增长潜力的公司构建最终股票组合。  
4. 债券投资策略  
本基金的债券投资采取主动投资策略,运用利率预测、久期管理、收益率曲线预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略以及利用正逆回购进行杠杆操作等积极的投资策略,力求获得超过债券市场的收益。  
5. 产品风险以及管理  
本基金属于区域类增长型股票基金,风险介于价值型股票基金与积极成长型股票基金之间,适于能承担一定风险,追求较高收益和长期资产增值的投资者投资。本基金运用追求量化风险管理系统和宝盈基金绩效评估系统进行风险管理。  
6. 投资决策  
1. 决策依据  
(1) 国内国际宏观经济环境;  
(2) 国家财政、货币政策、产业政策、区域规划与发展政策;  
(3) 证券市场的发展水平和走势及基金业发展状况;  
(4) 上市公司的行业发展状况、景气指数及竞争优势;  
(5) 上市公司盈利能力、增长能力和创新能力,以及对公司综合价值的评估结论;  
(6) 国家有关法律、法规和基金契约的有关规定;  
2. 决策程序  
本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制,投资决策程序如下:  
(1) 在基金合同规定的投资方向、投资理念和投资限制的范围内,基金经理根据市场和外部专业研究机构对宏观经济、政策取向、市场趋势和热点进行的深入研究,在此基础上制定资产配置策略和投资策略建议,经过投资决策委员会讨论通过后作为进行整体资产配置决策依据;  
(2) 公司投资部行业研究员和金融工程部数量分析研究员对上市公司进行详细分析、调研的基础上,构建基金投资组合,推荐给基金经理。基金经理根据基金契约规定、整体资产配置方案,适当参考外部专业研究机构的投资建议报告,在公司统一的投资决策库中选择合适的投资品种;  
(3) 基金经理结合自己对市场的分析和判断制定投资组合草案,提交投资决策委员会审议。投资组合包括计划投资股票的数量和数量范围;  
(4) 投资决策委员会对基金经理的投资组合草案进行讨论和表决,通过后形成投资组合方案;如草案未获通过,基金经理负责对投资组合进行修改,提交投资决策委员会继续讨论;  
(5) 基金经理根据投资组合方案制定具体的操作计划,构建投资组合;  
(6) 金融工程部对投资组合进行风险评估,并将评估结果和调整建议向投资决策委员会反馈;  
(7) 投资决策委员会和基金经理根据市场变化和风险评估结果对基金投资组合进行调整。

**九、业绩比较基准**  
本基金业绩比较基准为:  
上证A股指数×80%+上证国债指数×20%  
当市场出现合适的全球统一指数时,本基金股票部分的业绩比较基准将适时调整为全球统一指数。

**十、基金的风险收益特征**  
本基金属于区域类增长型股票基金,风险介于价值型股票基金与积极成长型股票基金之间,适于能承担一定风险,追求较高收益和长期资产增值的投资者投资。

**十一、基金投资组合报告(截止2010年12月31日)**

(一)基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产比例(%)
1	权益投资	1,948,080,210.80	91.47
2	固定收益	1,948,080,210.80	91.47
3	其他资产	1,946,577.60	0.09
4	负债及净资产	1,946,577.60	0.09
5	银行存款和结算备付金合计	172,337,355.50	8.09
6	其他负债	7,380,128.02	0.35
7	合计	2,129,744,271.92	100.00

(二)行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农林牧渔	3,688,474.28	0.17
B	制造业	100,680,000.00	4.75
C0	食品饮料	616,833,620.24	29.11
C1	食品饮料	59,595,400.00	2.81
C2	纺织服装	-	-
C3	木材、家具	-	-
C4	医药、生物	-	-
C5	化学、石化、塑胶、塑料	36,290,210.92	1.71
C6	电子	10,828,725.42	0.51
C7	金属、非金属	215,034,622.24	10.15
C8	机械、设备、仪表	259,084,656.66	13.93
C9	医药、生物	-	-
D	电力、煤气、水生产和供应业	70,490,817.06	3.33
E	建筑业	76,600,772.22	3.62
F	交通运输、仓储业	531,842,372.81	25.10
G	信息技术	188,526,627.00	8.90
H	批发和零售业	30,709,924.20	1.45
I	房地产业	277,797,141.98	13.11
J	金融业	-	-
K	社会服务业	-	-
L	传播与文化产业	15,739,575.00	0.74
M	综合类	35,200,836.01	1.66
合计		1,948,080,210.80	91.95

(三)基金投资前十名股票明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600050	中国联通	21,000,000	112,390,000.00	5.30
2	000888	鞍钢股份	13,372,885	103,372,401.05	4.88
3	601919	中国远洋	10,696,184	100,544,129.60	4.75
4	601111	中国国航	6,399,200	87,541,056.00	4.13
5	600029	南方航空	8,350,000	81,329,000.00	3.84
6	600099	上海机场	6,440,935	79,803,184.65	3.77
7	601186	中国铁建	11,298,049	76,600,772.22	3.62
8	601939	建设银行	16,049,922	73,669,141.98	3.48
9	000040	许继电气	2,200,000	73,216,000.00	3.46
10	000063	中兴通讯	2,120,000	57,876,000.00	2.73

(四)债券种类和比例的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债	-	-
5	企业债券	-	-
6	企业短期融资券	-	-
7	可转债	1,946,577.60	0.09
8	其他	-	-
合计		1,946,577.60	0.09

(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资组合

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110011	歌华转债	15,840	1,946,577.60	0.09
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-